

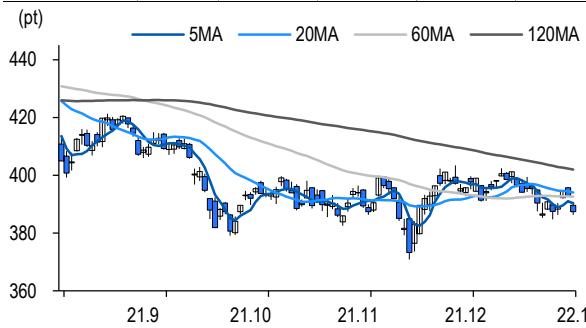


선물옵션시장 지표

2022.1.18

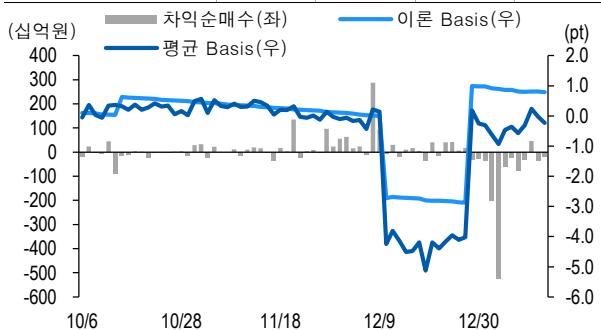
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	383.81	-0.94	-3.64	6,873.6	-
선물 3월물	384.30	-0.57	-2.20	21,386.5	253,877
선물 6월물	384.55	-0.61	-2.35	13.9	10,835
2월물(mini)	384.30	-0.58	-2.24	1,466.0	38,808
3월물(mini)	384.30	-0.57	-2.18	4.4	2,946



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.79	-0.23	0.49	-0.27%
베이시스(mini)	0.36	-0.27	0.49	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.72	0.33	0.35	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.36	0.45	0.45	0.02%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-251.7	10.8	-241.0	-0.5	-142.0	-651.6	2.1	-2.0	0.0	19.7
개인	481.9	19.6	501.6	0.0	2.3	30.7	17.6	0.4	0.4	-21.8
기관	-259.4	-41.6	-301.0	-17.0	-96.9	619.4	-20.6	1.9	-0.4	1.8
금융투자	31.7	-65.5	-33.8	-38.8	-1.5	448.9	-18.1	2.1	-0.3	43.4
투신	-79.5	4.8	-74.7	0.0	-25.6	136.2	-2.4	-0.3	0.0	-3.4
은행+보험+기타금융	-51.5	33.2	-18.4	0.0	-21.0	14.8	0.0	0.0	-0.1	0.9
연기금+국가지자체	-75.8	-8.6	-84.4	21.8	-41.6	19.5	0.0	0.0	0.0	-39.1
기타법인	29.3	11.1	40.4	0.0	2.2	1.5	0.8	-0.3	0.0	0.3

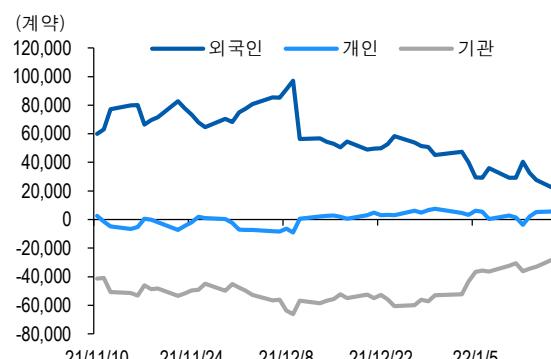
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



지수옵션 시장동향

거래량		거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	527,043	158.3	557,877	15.0%	지수옵션 전체	1,152,356	402.7	1,505,233
Put	625,313	244.4	947,356	16.1%	PCR(금액기준)	1.54	VKOSPI	17.53%(+0.56%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	395.0(K+3)	2.11	-0.79	40,642	11,153	3,043	14.9	Put	390.0(K+1)	9.44	1.10	1,789	6,181	-117	15.1
	392.5(K+2)	2.82	-0.94	27,030	5,326	2,301	15.1		387.5(K+0)	7.98	0.95	2,802	6,668	26	15.4
	390.0(K+1)	3.70	-1.09	19,187	8,032	1,829	15.3		385.0(K-1)	6.67	0.77	4,393	17,102	306	15.6
	387.5(K+0)	4.74	-1.26	8,114	2,960	978	15.6		382.5(K-2)	5.59	0.65	6,811	7,875	338	16.0
	385.0(K-1)	5.95	-1.41	5,510	2,791	1,425	15.8		380.0(K-3)	4.64	0.56	14,723	10,940	572	16.3

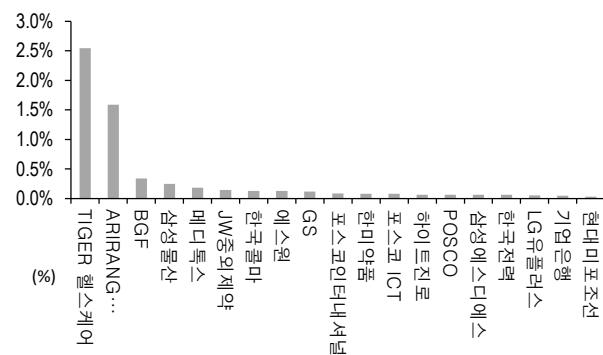
자료: KRX, 유안타증권 리서치센-

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센-

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,805,124	3,310.2	4,495,955	349,578	30,311	-79,523	47,655	19.7	-21.8	1.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	42,850	-0.58	18.1	117.1	39,074	-7,535	-0.07%	1,450	-477	-723	2,844	3,931
SK 하이닉스	127,500	-0.78	383.4	81.7	166,963	12,520	-0.04%	4,808	3,271	-8,738	-7,608	-420
삼성전자	77,400	0.13	510.2	75.3	1,255,720	-1,904	-0.22%	2,194	-20,155	18,905	31,868	-14,471
POSCO	292,500	-2.34	56.3	75.2	22,702	1,136	0.06%	1,212	193	-1,487	-342	-1,145
엔씨소프트	590,000	1.37	42.1	70.8	11,568	189	-0.04%	228	-4	-224	-263	39
LG 화학	706,000	-1.26	130.0	69.9	14,304	554	-0.20%	686	-191	-324	132	265
LG 전자	141,000	-3.75	167.7	69.0	36,360	-2,090	-0.02%	1,914	-2,583	712	3,324	-2,820
LG 이노텍	360,500	-6.24	233.0	63.9	16,510	3,212	-0.01%	-491	3,282	-2,857	-59	-2,982
NAVER	344,000	0.44	88.9	62.1	35,401	1,198	-0.06%	-395	557	-189	363	-552
SK 이노베이션	266,000	1.14	74.9	61.0	39,465	4,009	0.02%	866	-820	-96	345	-3,119

자료: KRX, 유안타증권 리서치센-